

财达证券睿达季季悦享 2 号集合资产管理计划  
2023 年第四季度资产管理报告



管理人：财达证券股份有限公司

托管人：招商银行股份有限公司北京分行

报告期间：2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日

# 目 录

|   |   |
|---|---|
| § 1 重要提示.....   | 3 |
| § 2 集合计划简介.....   | 3 |
| § 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况.....                               | 3 |
| 3.1 主要财务指标.....   | 3 |
| 3.2 净值表现.....   | 4 |
| 3.3 收益分配情况.....   | 4 |
| § 4 管理人报告.....  | 4 |
| 4.1 投资经理简介.....   | 4 |
| 4.2 管理人对报告期内本集合计划运作遵规守信情况的说明.....                         | 4 |
| 4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告.....                             | 4 |
| 4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望.....                       | 5 |
| § 5 投资组合报告.....   | 6 |
| 5.1 期末资产组合情况.....   | 6 |
| 5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....                     | 6 |
| 5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细.....                     | 6 |
| 5.4 本报告期投资基金情况.....                                       | 6 |
| 5.5 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明.....                   | 7 |
| 5.6 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明.....                            | 7 |
| 5.7 本集合计划运用杠杆情况.....                                      | 7 |
| 5.8 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明.....                      | 7 |
| 5.9 投资组合报告附注或其他描述（如有）.....                                | 7 |
| § 6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式.....               | 7 |
| § 7 本集合计划份额变动.....  | 8 |
| 7.1 本报告期份额变动情况.....                                       | 8 |
| 7.2 本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况..... | 8 |
| § 8 重大事件揭示.....   | 9 |
| 8.1 投资经理变更.....   | 9 |
| 8.2 一般关联交易及重大关联交易.....                                    | 9 |
| 8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件.....                              | 9 |
| § 9 备查文件目录.....   | 9 |
| 9.1 备查文件目录.....   | 9 |
| 9.2 存放地点.....   | 9 |
| 9.3 查阅方式.....   | 9 |



## § 1 重要提示

本集合计划管理人保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，保证报告内容的真实性、准确性和完整性。

本集合计划托管人根据本集合计划合同规定复核了本报告中的主要财务指标、净值表现、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

本集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的合同、说明书、风险揭示书等文件。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中的内容由管理人负责解释。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 集合计划简介

|           |                        |
|-----------|------------------------|
| 集合计划名称    | 财达证券睿达季季悦享 2 号集合资产管理计划 |
| 产品类型      | 固定收益类集合资产管理计划          |
| 集合计划成立日期  | 2023/2/22              |
| 集合计划合同存续期 | 9 年                    |
| 集合计划风险等级  | 中低风险（R2）的产品            |
| 推广对象      | 适合谨慎型（C2）（含）以上投资者      |
| 管理人       | 财达证券股份有限公司             |
| 托管人       | 招商银行股份有限公司北京分行         |
| 注册登记机构    | 财达证券股份有限公司             |

## § 3 主要财务指标、净值表现及收益分配情况

### 3.1 主要财务指标

| 科目            | 金额（单位：元）       |
|---------------|----------------|
| 实收资本          | 176,427,576.27 |
| 期末本集合计划资产净值   | 186,953,964.48 |
| 期末本集合计划份额净值   | 1.0597         |
| 期末本集合计划份额累计净值 | 1.0597         |
| 报告期份额累计净值增长率  | 2.0119%        |

注：期末份额净值=期末本集合计划资产净值÷期末本集合计划份额  
期末份额累计净值=期末本集合计划份额净值+每份本集合计划份额累计分红  
报告期份额累计净值增长率=（期末累计净值-期初累计净值）/期初单位净值

### 3.2 净值表现

截至本报告期末,本集合计划份额净值为【1.0597】元,份额累计净值为【1.0597】元。本报告期份额累计净值增长率为【2.0119】%。

### 3.3 收益分配情况

报告期内,本集合计划未进行收益分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 投资经理简介

曲雯慧：财达证券股份有限公司北京资管部投资经理，无兼职情况。高丽大学经济学硕士，具备证券从业资格、基金从业资格，并已在证券投资基金业协会完成注册。曾任中航证券资产管理总部交易员、投资经理助理、交易主管，2022年加入财达证券。

本集合计划投资经理，最近三年未被监管机构采取重大行政监管措施、行政处罚。

### 4.2 管理人对报告期内本集合计划运作合规守信情况的说明

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，严格依据法律法规、资产管理合同的约定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，为本集合计划持有人谋求最大利益，无损害持有人利益的行为。本集合计划投资组合符合有关法律法规及资产管理合同的约定。

### 4.3 管理人对报告期内本集合计划的风险控制报告

本报告期内，财达证券股份有限公司作为本集合计划管理人，始终按照有关法律法规、公司制度和本集合计划资产管理合同的要求，对本集合计划进行运作管理，通过风险监测和预警机制及时发现运作过程中可能出现的风险状况。本集合计划的投资决策、

投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求，未出现异常交易、操纵市场的现象，未发现内幕交易情况。

#### 4.4 报告期内本集合计划的投资策略和运作分析及市场简要展望

2023年四季度，债券市场利率整体呈现先上后下区间震荡的走势，10年期国债利率基本在2.6%-2.75%区间内波动，年底跌至2.56%，利率高点大致出现在11月底到12月初区间内，年底接近23年全年低点。具体来看，10月仍受稳地产政策逐步落地，经济金融数据超预期，特殊再融资债巨量发行带动资金面持续偏紧，以及增发国债的影响，长端利率持续回升，10年期国债收益率最高上行至2.72%。同期，资金面收紧亦驱动短端利率快速上行，且上行幅度大于长端，债市呈现熊平行行情。11月起，受经济再现下行波动，宽货币预期持续升温，以及股市下跌等因素提振，长端利率转而下行，10年期国债收益率已降至2.56%，接近8月超预期降息后达到的年内最低点。短端利率走势则先上后下，11月至12月上旬资金价格持续居于高位，特别是同业存单利率在政策利率上方持续上行，债市短端利率继续冲高，但自12月中旬起，央行资金投放增加，当月MLF大幅加量续作，带动资金面转松，短端利率开始回落。这一阶段，随短端利率走势切换，收益率曲线先延续平坦化、后有所走陡。

展望2024年一季度，基本面仍将是债券市场波动空间的主要影响因素。在持续的政策刺激下，消费的需求复苏较为显著，但是由于整体经济复苏仍不足，市场对于经济复苏的预期仍有趋弱。如果地产市场出现持续性改善，则可能改变债券市场目前的基本面预期。北京上海等地调整地产政策后，二手房成交有所回暖，但短期内地产投资或将复苏有限。12月数据显示新出口订单指数再度回落，短期内出口增速预计维持弱景气水平；票据利率整体维持偏低水平，指向信贷动能偏弱。流动性方面，目前看仍有一定不确定性，节后逆回购到期规模较大，资金面或面临一定压力。同时，政府债供给压力边际下降，市场或继续围绕降息预期博弈。总体来说，一季度数据真空期将至，在需求不足、基本面偏弱状态延续的情况下，利率或维持震荡偏强趋势。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 期末资产组合情况

| 序号 | 项目       | 金额（元）          | 占总资产的比例（%） |
|----|----------|----------------|------------|
| 1  | 银行存款     | 248,145.24     | 0.11%      |
| 2  | 结算备付金    | -              | 0.00%      |
| 3  | 存出保证金    | 1,232.80       | 0.00%      |
| 4  | 交易性金融资产  | 211,034,508.45 | 94.29%     |
|    | 其中：股票投资  | -              | 0.00%      |
|    | 债券投资     | 211,034,508.45 | 94.29%     |
|    | 基金投资     | -              | 0.00%      |
|    | 权证投资     | -              | 0.00%      |
|    | 资产支持证券   | -              | 0.00%      |
| 5  | 衍生金融工具   | -              | 0.00%      |
| 6  | 买入返售金融资产 | -              | 0.00%      |
| 7  | 其他资产     | 12,520,000.00  | 5.59%      |
|    | 合计       | 223,803,886.49 | 100.00%    |

注：其他资产包括应收证券清算款、应收利息、应收股利、应收申购款等。

### 5.2 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码         | 债券名称                  | 数量（张）   | 公允价值（元）       | 占资产净值比例（%） |
|----|--------------|-----------------------|---------|---------------|------------|
| 1  | 032300408.IB | 23 唐山控股 PPN002        | 150,000 | 15,139,500.00 | 8.0980     |
| 2  | 102383363.IB | 23 冀中能源 MTN012A(科创票据) | 150,000 | 15,066,270.00 | 8.0588     |
| 3  | 251224.SH    | 23 驻投 01              | 100,000 | 10,210,030.00 | 5.4613     |
| 4  | 042300049.IB | 23 津南城投 CP002         | 100,000 | 10,175,800.00 | 5.4429     |
| 5  | 252172.SH    | 23 渝滨 02              | 100,000 | 10,123,560.00 | 5.4150     |

### 5.3 期末按公允价值占资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本报告期末未持有股票。

### 5.4 本报告期投资基金情况

本报告期末未持有基金。

### 5.5 报告期末本集合计划投资股指期货、商品期货、国债期货的情况说明

本报告期末未持有期货。

### 5.6 报告期末本集合计划投资金融衍生品的情况说明

本报告期末未参与金融衍生品投资。

### 5.7 本集合计划运用杠杆情况

截至报告期末，本集合计划杠杆倍数（总资产/净资产）为【119.71】。

报告期，本集合计划严格按照合同要求开展投资，控制杠杆比例，未出现违反合同约定的情况。

### 5.8 本集合计划投资关联方发行的或者承销期内承销的证券的说明

本报告期内，本集合计划无投资于管理人、托管人关联方发行的或者承销期内承销的证券的情况。

### 5.9 投资组合报告附注或其他描述（如有）

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §6 管理费、托管费、业绩报酬（如有）等费用的计提基准、计提方式和支付方式

| 费用明细         | 计提基准   | 计提方式  | 支付方式   |
|--------------|--|---|--|
| 管理费          | $H = E \times 【0.5】\% \div 365$<br>H 为每日应计提的管理费<br>E 为前一日的集合计划资产净值                       | 每日计提  | 按季支付   |
| 托管费          | $H = E \times 【0.01】\% \div 365$<br>H 为每日应计提的托管费<br>E 为前一日的集合计划资产净值                      | 每日计提  | 按季支付   |
| 业绩报酬<br>（如有） | 具体业绩报酬计提基准以产品实际发行时为准，业绩报酬计提基准在发行前及开放前由管理人确定并在管理网站发布公告。<br>每笔参与份额以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日到本次业 | 业绩报酬计提日为收益分配基准日、委托人退出申请日或集合计划终止日。<br>若年化收益率 $R \geq$ 业绩报酬计提基准，则 | 提取频率不超过每6个月一次。因投资者退出资产管理计划，按照资产管理合同的约定提取业绩报酬的，不受前述提取频率的限 |

|  |                           |   |    |
|--|---------------------------|---|----|
|  | 绩报酬计提日的年化收益率,作为计提业绩报酬的基准。 | 计提比例为 60%, 业绩报酬 (Y) 的计提公式为:<br>$Y=N \times P_0^* \times (R - \text{业绩报酬计提基准}) \times 60\% \times D \div 365$<br>Y=业绩报酬; N=业绩报酬计提日委托人每笔符合业绩报酬计提条件的份额;<br>$P_0^*$ =上一个发生业绩报酬计提日的计划单位净值。 | 制。 |
|--|---------------------------|---|----|

## § 7 本集合计划份额变动

### 7.1 本报告期份额变动情况

单位：份

|             |                |
|-------------|----------------|
| 本报告期期初份额总额  | 152,873,292.37 |
| 本报告期总申购份额   | 62,395,584.36  |
| 减：本报告期总赎回份额 | 38,841,300.46  |
| 本报告期期末份额总额  | 176,427,576.27 |

注：总申购份额含红利再投

### 7.2 本报告期管理人董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与本集合计划情况

| 项目      | 持有份额总数（份）    | 占总份额比例 |
|---------|--------------|--------|
| 持有本集合计划 | 2,471,839.96 | 1.39%  |

经对本集合计划账户进行监控,未发现存在因管理人关联方参与本集合计划导致的不公平对待投资者行为。



## § 8 重大事件揭示

### 8.1 投资经理变更

本报告期内，未发生投资经理变更情况。

### 8.2 一般关联交易及重大关联交易

本报告期内，未发生重大关联交易。

### 8.3 本报告期对本集合计划发生的重大影响事件

本报告期内，未发生其他涉及投资者权益的重大事项。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1. 《财达证券睿达季季悦享2号集合资产管理计划资产管理合同》、说明书、风险揭示书；
2. 管理人业务资格批复、营业执照；
3. 本集合计划各项公告。

### 9.2 存放地点

备查文件存放于管理人办公场所：河北省石家庄市自强路35号

### 9.3 查阅方式

投资者可登录管理人网站www.95363.com查询。

客户服务电话：95363（河北区域投资者请致电95363，河北省外区域投资者请致电0311-95363）

投资者对本报告书如有疑问，可咨询管理人财达证券股份有限公司。

